

# Protokoll der 93. ordentlichen Mitgliederversammlung der Schweizerischen Aktuarvereinigung vom 31. August 2002 in Brunnen

Objekttyp: **AssociationNews**

Zeitschrift: **Mitteilungen / Schweizerische Aktuarvereinigung = Bulletin /  
Association Suisse des Actuaires = Bulletin / Swiss Association of  
Actuaries**

Band (Jahr): - **(2002)**

Heft 2

PDF erstellt am: **22.07.2024**

## **Nutzungsbedingungen**

Die ETH-Bibliothek ist Anbieterin der digitalisierten Zeitschriften. Sie besitzt keine Urheberrechte an den Inhalten der Zeitschriften. Die Rechte liegen in der Regel bei den Herausgebern.

Die auf der Plattform e-periodica veröffentlichten Dokumente stehen für nicht-kommerzielle Zwecke in Lehre und Forschung sowie für die private Nutzung frei zur Verfügung. Einzelne Dateien oder Ausdrucke aus diesem Angebot können zusammen mit diesen Nutzungsbedingungen und den korrekten Herkunftsbezeichnungen weitergegeben werden.

Das Veröffentlichen von Bildern in Print- und Online-Publikationen ist nur mit vorheriger Genehmigung der Rechteinhaber erlaubt. Die systematische Speicherung von Teilen des elektronischen Angebots auf anderen Servern bedarf ebenfalls des schriftlichen Einverständnisses der Rechteinhaber.

## **Haftungsausschluss**

Alle Angaben erfolgen ohne Gewähr für Vollständigkeit oder Richtigkeit. Es wird keine Haftung übernommen für Schäden durch die Verwendung von Informationen aus diesem Online-Angebot oder durch das Fehlen von Informationen. Dies gilt auch für Inhalte Dritter, die über dieses Angebot zugänglich sind.

---

## Protokoll der 93. ordentlichen Mitgliederversammlung der Schweizerischen Aktuarvereinigung vom 31. August 2002 in Brunnen

### 1. Begrüssung durch den Präsidenten

Der Präsident, Professor Dr. Herbert Lüthy, eröffnet die 93. ordentliche Mitgliederversammlung um 08.30 Uhr im schönen Saal des Hotels Waldstätterhof in Brunnen. Einen speziellen Gruss richtet er an die Referenten W. James MacGinnitie und Prof. Dr. Bernd Schips.

Eine Erweiterung der Traktandenliste wird nicht gewünscht.

### 2. Jahresbericht des Präsidenten

Den Jahresbericht des Präsidenten finden Sie in seiner vollständigen Version auf den Seiten 73–86 dieses Heftes. Dieser Bericht wird vom Auditorium mit grossem Interesse verfolgt und unter Applaus verdankt.

### 3. Ernennung korrespondierender Mitglieder

Der Vorstand hat beschlossen, der Mitgliederversammlung zwei bekannte Persönlichkeiten aus der amerikanischen Aktuarwelt zur Ernennung zu korrespondierenden Mitgliedern vorzuschlagen:

Die Herren W. James MacGinnitie und Samuel Cox

Unser Ehrenpräsident Professor Dr. Hans Bühlmann hält in seiner Laudatio für W. James MacGinnitie fest, dass es sich bei diesem um einen echten «actuaris universalis» handle, dem aufgrund seiner Ausbildung, seiner vielseitigen Tätigkeit und der Studienreisen in der ganzen Welt höchste Ehre gebühre.

Professor Dr. Hans-Ueli Gerber informiert über die Tätigkeit und die hohe Anerkennung, die Samuel Cox in aktuariellen Kreisen geniesst.

Die Mitgliederversammlung gibt mit kräftigem Applaus die Zustimmung zu den beiden Ernennungen und unser Präsident übergibt den Genannten die Ernennungs-urkunden.

#### **4. Issues in the Actuarial Education**

Referat von W. James MacGinnitie, President of the SOA

Der soeben zum korrespondierenden Mitglied der SAV ernannte Referent dankt für die ihm und seinem Kollegen Sam Cox erzeigte Ehre und bekräftigt seine guten Beziehungen zur Schweiz und vielen Kollegen aus unserer Vereinigung.

Seine interessanten Ausführungen zur Aktuarausbildung zeigen die in der angelsächsischen Welt üblichen Wege im Detail auf. Sehr deutlich bringt er zum Ausdruck, dass er die von uns eingeschlagene Variante, die sich stark an die Hochschulen anlehnt, auch für sein Land begrüßen würde. Mit herzlichem Applaus werden seine Ausführungen verdankt.

#### **5. Demographie, wirtschaftliche Entwicklung und soziale Sicherheit**

Referat von Prof. Dr. Bernd Schips, Leiter KOF der ETH Zürich

Die sich abzeichnenden demographischen Veränderungen werden bislang überwiegend nur aus dem Blickwinkel der Finanzierung umlagebasierter Altersvorsorgesysteme und der zu erwartenden Auswirkungen auf die Kosten der Gesundheitssysteme thematisiert. Der demographisch bedingte Alterungsprozess – der bereits heute ein globales Problem ist, auch wenn in den nächsten Jahrzehnten zuerst vor allem die Industrieländer davon stark betroffen sein werden – tangiert aber neben der Sozialpolitik noch andere Bereiche der Wirtschafts- und Finanzpolitik. Die im Durchschnitt zumindest für längere Zeit älter werdenden Erwerbstätigen, das zurückgehende Arbeitsangebot und die sich mit einiger Sicherheit ändernde Nachfragestruktur der Wohnbevölkerung konfrontieren die Politik mit neuen Herausforderungen. Wie kann das potentielle Arbeitsangebot besser ausgelastet bzw. vergrößert werden? Welche Möglichkeiten zur Aufrechterhaltung der gesamtwirtschaftlichen Produktivität und damit zur Sicherung des für die Finanzierung der Sozialwerke notwendi-

gen Wirtschaftswachstums gibt es? Resultieren aus dem in einigen Jahren zu erwartenden Kapitalabbau der Altersvorsorgeeinrichtungen spezifische Probleme und mit welchen Vorkehrungen kann diesen Schwierigkeiten begegnet werden? Derartige Fragen stehen im Zentrum des Referates. Angesichts der zu erwartenden Bevölkerungsentwicklung wird zudem aufgezeigt, dass das zur Lösung der anstehenden Probleme zur Verfügung stehende Zeitfenster nur noch relativ schmal ist.

Die klare Darstellung der uns zurzeit sehr intensiv berührenden Fragen dieses Referates werden mit kräftigem Applaus aufgenommen.

## **6. Protokoll der 92. ordentlichen Mitgliederversammlung**

Diskussionslos wird das im Heft 2/2001 der Mitteilungen veröffentlichte Protokoll genehmigt und dem Verfasser Hans-Jürg Studer verdankt.

## **7. Rechnung über das Jahr 2001, Bericht der Rechnungsrevisoren und Décharge an den Vorstand**

Der Präsident hält fest, dass die vom Quästor Prof. Dr. Raymond Schmutz erstellte Rechnung von den Revisoren geprüft und in Ordnung befunden wurde und im Heft 1/2002 der Mitteilungen abgedruckt ist. Weder der Quästor noch die Revisoren möchten Ergänzungen anbringen. Die Mitgliederversammlung nimmt zustimmend Kenntnis und erteilt dem Vorstand einstimmig Décharge.

## **8. Festlegung der Jahresbeiträge**

Der Vorstand beantragt keine Erhöhung der Beiträge im nächsten Jahr, was von der Versammlung begrüsst wird.

## **9. Wahl eines Rechnungsrevisors**

Der Vorsitzende dankt den Revisoren für ihre Arbeit. Statutengemäss scheidet Beat Müller aus. Zur Nachfolge hat sich Dr. Ruprecht Witzel von der Winterthur bereit erklärt. Die Versammlung wählt ihn ohne Gegenstimme.

## **10. Aktuelles aus dem Bereich der Öffentlichkeitsarbeit**

Arnold Schneiter orientiert über die vielen, in letzter Zeit grosse Wellen werfenden Probleme, denen sich die SAV stellen musste. Die Arbeit seines Bereichs lässt sich in folgende Gebiete aufteilen:

- Kontakte mit Medien und Politikern
- Mitwirkung bei parlamentarischen Kommissionen
- Stellungnahmen zu Vernehmlassungen von Gesetzesentwürfen
- Pressekonferenzen
- Communiqués
- Mitwirkung bei Fragen der Rechnungslegung

Die Schwerpunkte liegen bei Revisionen verschiedener Sozialversicherungsgesetze, insbesondere der BVG-Revision und dem umstrittenen BVG-Mindestzins.

Die hohen Kosten der Sozialversicherungen veranlassen die Politik zu langen Beratungen und lassen Meinungsverschiedenheiten zwischen National- und Ständerat aufblühen, die zu Verzögerungen der Entscheide führen. Die Sicherheits- und Gesundheitskommission des Ständerates berät zurzeit die vom Nationalrat im Mai 2001 knapp angenommene Vorlage zur 11. AHV-Revision und die vom Nationalrat im April 2002 angenommene Vorlage zur 1. BVG-Revision.

Die vom Bundesrat kurz vor den Sommerferien bekannt gegebene Herabsetzung des BVG-Mindestzinssatzes löste neue Beratungen in der Nationalrats- und Ständeratskommission aus, die sich auf Empfehlungen der BVG-Kommission vom 19. August 2002 abstützen. Da im Herbst eine Sondersession stattfindet, hat der SAV-Vorstand in seiner Sitzung vom 30. August 2002 ein Communiqué verabschiedet und an der Pressekonferenz abgegeben (vgl. z.B. NZZ vom 2. September 2002). Mit dem Hinweis auf die Kosten von rund 12 Mrd. die durch die Annahme der Sozialwerkrevision entstehen, schliesst Arnold Schneiter sein Referat.

## **11. Aktuelles zur Rechnungslegung**

René Ruchti berichtet über die Tätigkeit der vor zwei Jahren gegründeten und unter seiner Leitung stehenden Kommission Rechnungslegung, die auf grosses Interesse stösst. Die 18 Kommissionsmitglieder vertreten die Leben- und Nichtlebenversicherer, die Rückversicherer, die Revisionsgesellschaften und die Aufsichtsbehörde

(BPV). Gearbeitet wird in zwei Arbeitsgruppen (Leben und Nichtleben). Im internationalen Gremium, der IASC, wird die SAV durch Guy Castagnoli vertreten. Das Aufgabengebiet umfasst die IAS für Versicherungsgesellschaften in der Schweiz. Zur Anwendung von IAS19/FER16 bei Pensionskassen hat die Kammer der Pensionskassenexperten Stellung genommen, die von der SAV übernommen werden konnte.

Als Schwerpunkte erwähnt René Ruchti die Entwicklung neuer Standards (IFRS) und Auslegungsfragen bestehender Bewertungsrechnungen wie z.B. US GAAP. Wichtig ist, bei der Erarbeitung von international gültigen Rechnungslegungsvorschriften, deren Auswirkung auf schweizerische Besonderheiten abzuklären, an internationalen Tagungen unsere Wünsche einzubringen und Guidelines für die IAS-konforme Bewertung von Schweizer Versicherungsprodukten zu erarbeiten. Definitionen müssen klar abgestimmt werden, sollen doch die Regeln für «Versicherungsverträge» gelten. Die Frage der Überschussbeteiligung scheint auch nicht eindeutig in die internationalen Bewertungen zu passen etc.

Die Arbeit der Kommission stösst auf reges Interesse, zeigt sie doch Einblicke in eine wesentliche Teilaufgabe des zukünftigen Aktuars.

## **12. Sommerschule 2003**

Der Organisator André Dubey gibt bekannt, dass nach zweijähriger Pause vom 22. bis 26. September 2003 eine Sommerschule stattfindet. Anmeldeformulare liegen auf und werden noch an alle Mitglieder versandt. Anmeldeschluss ist der 30. April 2003. Alois Gisler, der zusammen mit Hans Bühlmann für den wissenschaftlichen Teil dieser Tagung mit dem Titel «Credibility and its Applications» verantwortlich zeichnet, erklärt, dass die Grundlage in der Vorversion eines neuen Buches, verfasst von den beiden genannten Professoren, besteht. Damit auch das Lokalkolorit mitspielen kann, wird die Sommerschule unweit von Brunnen, nämlich in Emmetten, auf der gegenüberliegenden Seite des Vierwaldstättersees stattfinden.

## **13. Mitgliederversammlung 2003**

Peter Diethelm freut sich darüber, dass der Vorstand für die nächste Versammlung wiederum einen Ort an einem wunderschönen See bestimmt hat und hofft auf rege Teilnahme am 5./6. September 2003 in Genf.

Die Tagung wird in der Universität Dufour stattfinden, das Bankett im Hotel Noga-Hilton.

#### **14. Verschiedenes**

Der Ehrenpräsident dankt dem Präsidenten Herbert Lüthy für die effiziente Durchführung der Versammlung und vor allem für die grossen Arbeiten, die er während des ganzen Jahres für die Vereinigung geleistet hat. In den Dank schliesst er auch die Organisatoren des Anlasses und die vielen in Vorstand und Kommissionen tätigen Kolleginnen und Kollegen mit ein.

Um 12.30 Uhr kann der Präsident die Versammlung mit nochmaligem Dank an alle Teilnehmer schliessen.

Für das Protokoll: *H.-J. Studer*

---

## Laudatio for W. James MacGinnitie

Actuaries have become more and more specialized. There are Life Actuaries, Casualty Actuaries, Pension Actuaries, Valuation Actuaries, Financial Actuaries, Reinsurance Actuaries, just to name a few.

It is my privilege to introduce to you today an actuary who unifies all the specialties in one person: W. James MacGinnitie (better known as Jim). He is a truly universal actuary. I prefer to say it in Latin ACTUARIUS UNIVERSALIS. In a way it is a miracle to see that the ACTUARIUS UNIVERSALIS is still possible today. But the miracle is true. Yes, the person stands right here in front of you.

Jim MacGinnitie has received his solid mathematical education at Amherst (Massachusetts) and at Northwestern University (Evanston). He also has passed the Fellowship Exams of both the Casualty Actuarial Society and the Society of Actuaries at the early age of 25 and 29. (Already this fact to have passed both exams is a distinction of rare occurrence among North American Actuaries, only 30 out of 9000 living Fellows have achieved this.)

The first employer of Jim MacGinnitie was CNA (one of these US insurance multiline giants with headquarters in Chicago). He started there at the age of 22 as Actuarial Trainee. Later, a few years before retirement, he returned to this same company as Chief Financial Officer. You will get an idea of Jim's universality when you hear what he did in between. (Of course my enumeration must remain sketchy.)

He was Actuary of a large multiline insurer in Bogotá, Colombia. Then he became Professor of Actuarial Science and Director of the Actuarial Program at the University of Michigan, Ann Arbor. That is where he was a colleague of Hans Gerber and where I met Jim for the first time. When Jim MacGinnitie left Ann Arbor he found his great challenge at Tillinghast. He initiated Casualty Actuarial consulting at this firm and grew this activity into the largest in the world. As President of Tillinghast he merged the firm with Towers Perrin but then went back into the frontline consulting area, developing Actuarial Services for Ernst & Young before – as already mentioned – returning to his home base CNA in Chicago.

In all his activities Jim has always been – and still is – a true leader, not just an organizer and manager (of course he is that too) but a true actuary, a very talented professional. You can discuss with Jim on the entire spectrum of actuarial activity and you will find that you can always learn from him. Indeed true **universalism**.

To be universal also means to be international. Jim MacGinnitie knows the whole world and throughout the whole world he is very well known and respected. Already

at Tillinghast and then again at Ernst & Young he has built an international network. Nowadays his active involvement in high powered Actuarial Organizations reinforces these international contacts. At present, Jim MacGinnitie is president of the Society of Actuaries – the world's largest Nation based Actuarial Organization (17 000 members) and as President of SOA he is visiting its members around the world. Jim has been President of the Casualty Actuarial Society, President of the American Academy of Actuaries and he is President elect of IAA. Finally one should add that he is also member of the governing committees of ASTIN and IACA.

Jim and his wife Barbara, who already had helped him to pass the actuarial exams, are travelling extensively but I am proud to say that they are very special friends of Switzerland. This may have started when they met Hans Gerber in Ann Arbor, but since then their affection for our country has even grown. As passionate hikers they have, at several occasions, also explored the Swiss Alps.

Remaining on the family side, Barbara and Jim are happy parents of three children, Andy, Doug and Allison and proud grandparents of five grandchildren, Colin, Isabel, Hank, Katie and Anna (Number 6 is due mid-October). The whole MacGinnitie family is a very happy clan.

The Swiss Actuarial Society is very honored that both of you Barbara and Jim have joined us for this meeting. We thank you Barbara that you have helped Jim to pass the Actuarial Exams (imagine the loss to the profession if he had failed) and we thank you Jim for your eminent contributions to our profession and to Actuarial Science.

I would like to propose to our members to nominate W. James MacGinnitie Corresponding Member of the SAA.

*Hans Bühlmann*

---

## Laudatio for Samuel H. Cox

Ladies and Gentlemen, it is my pleasure to present to you Professor Samuel H. Cox. His friends call him Sam. So let's call him Sam.

Sam is Professor of Actuarial Science at Georgia State University in the Department of Risk Management and Insurance. He is the holder of the Thomas P. Bowles, Jr. Chair in Actuarial Science. In this function he has created the Annual Bowles Symposium, which has a truly international reputation.

Sam has a Ph.D. in Mathematics. He is a Fellow of the Society of Actuaries and a Chartered Property and Casualty Underwriter. He is currently a member of the Board of Governors of the Society of Actuaries.

Sam has an impressive list of publications, which reflect his broad interests. His papers range from purely mathematical to very practical, and they are well-known both in academia and in the profession. Sam is an author or a coauthor of several monographs. In particular, he is a coauthor of the text "Financial Economics, with Applications to Investment, Insurance and Pensions", which was published by the Society of Actuaries. His current research activities include interest rate term structure models, currency risk models and securitization of insurance risks and social security.

Sam has been the last editor of the Transactions of the Society of Actuaries (TSA) and the first editor of the North American Actuarial Journal (NAAJ), which replaced the TSA. Thanks to Sam, the NAAJ has become one of the leading actuarial journals in the world.

Sam has multiple ties to Switzerland. In fact, he is a member of our Association. More importantly, he was on the faculty of our 1997 International Summer School, which was about "Asset/Liability Management: From Immunization to the Theory of Option Pricing". Last but not least he developed a set of exercises for "Life Insurance Mathematics", and he made thereby a substantial contribution to the pedagogical success of this text, which was published by Springer and our Association.

Ladies and Gentlemen, on behalf of the board of the Swiss Association of Actuaries I propose that Samuel H. Cox shall be appointed a Corresponding Member of our Association.

*Hans U. Gerber*

## Höhere Fachprüfung für Pensionsversicherungsexperten

### 1. Vorprüfungen 2002

Vom 10. bis 12. September 2002 sind in Adliswil/Zürich Vorprüfungen durchgeführt worden. An diesen Prüfungen haben teilgenommen:

- 17 Personen für die Vorprüfung Teil A (Versicherungsmathematik)
- 16 Personen für die Vorprüfung Teil B (Rechts- und Sozialversicherungskunde).

Davon haben 9 Personen die Vorprüfung Teil A und 15 Personen die Vorprüfung Teil B mit Erfolg bestanden.

### 2. Hauptprüfung 2002

Am 17. und 18. September 2002 folgten dann in Bern die Hauptprüfungen. An den Prüfungen haben 4 Kandidaten teilgenommen. 3 Herren haben die Diplomprüfung mit Erfolg bestanden. Es sind dies:

- Herr *Christoph Furrer*, Zürich
- Herr *Roland Kirchhofer*, Zürich
- Herr *Rudolf Steiner-Pulimeno*, Zürich

Den erfolgreichen Absolventinnen und Absolventen sei auch an dieser Stelle herzlich gratuliert. Seit Bestehen unserer höheren Fachprüfung haben nun insgesamt 182 Personen das Diplom erworben.

Der Sekretär der Prüfungskommission: *R. Schmid*